

Fecha de Publicación: 18 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 16 de Abril de 2012 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$776,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,0	176,8	129,0	43,0	32,8	62,0	15,0
15-35	242,9	221,8	86,5	90,2	32,3	49,7	103,0
36-60	15,3	62,3	0,0	0,0	47,3	0,3	15,0
61-90	5,0	6,7	0,0	0,0	6,7	5,0	0,0
91-180	13,5	34,7	0,0	5,0	29,7	3,5	5,0
>180	10,2	5,8	0,0	0,0	5,8	10,2	0,0
Total	406,8	508,0	215,5	138,2	154,5	130,6	138,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operacines con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,3 %	3,8 %	5,5 %	4,6 %
15-35	4,7 %	6,4 %	5,6 %	5,5 %
36-60	5,2 %	5,5 %	4,2 %	5,4 %
61-90	-	5,9 %	5,1 %	5,6 %
91-180	4,9 %	4,5 %	3,9 %	4,5 %
>180	-	4,5 %	4,1 %	4,2 %
Total	5,2 %	4,7 %	5,4 %	5,1 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	109	2233	2478	11	168	2333	3116	8	61	1195	1269
Intragruppo y off-shore***	0	0	1436	594	0	0	1903	549	0	0	621	215
Otros	109	44	525	1123	168	11	405	976	61	8	298	630
Total	153	153	4195	4195	179	179	4641	4641	69	69	2114	2114

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.